

南方理财60天债券型证券投资基金

[2014] 第三季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及基金经理保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，于2014年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告未涉及财务数据未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方理财60天债券
交易代码	202306
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年10月10日
报告期末基金份额总额	886,607,257.05份

本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，努力追求绝对收益，为基金份额持有人保值增值。

本基金将采取积极管理的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在60天以内，从而在申购赎回时，降低基金收益。

业绩比较基准

七天通知存款利率

风险收益特征

本基金为货币市场基金中较低风险品种，其长期平均风险和预期收益率均低于货币基金，混合基金。

基金管理人

南方基金管理有限公司

基金托管人

中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称

南方理财60天债券A 南方理财60天债券B

报告期末基金的份额总额

875,503,804.00份 11,103,453.57份

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“南方理财60天”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
南方理财60天债券A	南方理财60天债券B
1.本期已实现收益	10,377,687.30 443,123.43
2.本期利润	10,377,687.30 443,123.43
3.期末可供分配利润	875,503,804.00份 11,103,453.57份

注:本期末可供分配利润即为本期已实现收益加上本期利润减去应付费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期利润减去应付费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期利润减去应付费用后的余额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方理财60天债券

阶段 净值收益率① 0.1214% 0.0135% 0.3450% 0.0000% 0.8688% 0.0135%

净值收益率标准差 ② 0.035% 0.0000% 0.0450% 0.0000% 0.9422% 0.0135%

3.2.2 业绩比较基准

注:1.本基金于2014年7月1日进行首次分红并开放,并在运作周期内未支付。

2.本基金计算分位数收益率所选取的评价周期,是以基金成立日期为起始日并持有至报告期末的基本份额所经历的运作周期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金净值收益率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金合同生效之日起60天,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	从业年限	说明
夏鹃娟	本基金基金经理	2012年10月19日	-	香港科技大学金融硕士,具有基金从业资格。2005年5月加入南方基金,曾担任基金工程部研究员、基金研究部研究员、基金研究部高级研究员,现任南方基金监察稽核部总监。2008年5月至今担任南方基金监察稽核部总监。2012年10月至今担任南方基金监察稽核部总监。夏鹃娟,专户产品开发部总监兼基金经理,负责专户产品开发工作,并担任公司旗下部分产品的基金经理。2013年1月至今,任南方理财60天债券基金经理;2013年1月至今,任南方货币基金基金经理;2013年1月至今,任南方现金管理基金经理;2013年7月至今,任南方现金管理基金经理;2014年7月至今,任南方现金管理基金经理。

注:1.对基金的任何基金合同,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解约日期,对基金的任何基金合同,其“任期期限”和“任职期限”指公司决定确定的解约日期和解约日期。

2.本基金的任何产品开发部总监和基金经理由公司决定的解约日期和解约日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内不存在违反《证券投资基金法》等有关法律法规、规章及行业自律规则的情况。

4.3 管理人对旗下账户构成情况的说明

本基金的任何基金合同,其“账户构成”指基金管理人持有的客户构成,本报告期未发现有损害基金份额持有人利益的情形,投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金的任何基金合同,其“公平交易制度”指基金管理公司公平交易制度指导意见,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平交易,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易名义总金额占所有投资组合名义总金额的比例较低,正向交易占主导地位,且不存在明显异常交易行为,未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.4.3 报告期内基金投资组合类别的分布情况

本基金的任何基金合同,其“投资组合类别”指股票、债券、商品及黄金等大类资产的配置比例。

4.4.4 报告期内基金的绩效评估说明

4.4.5 报告期内基金的正收益金额

4.4.6 报告期内基金的正收益金额

4.4.7 报告期内基金的正收益金额

4.4.8 报告期内基金的正收益金额

4.4.9 报告期内基金的正收益金额

4.4.10 报告期内基金的正收益金额

4.4.11 报告期内基金的正收益金额

4.4.12 报告期内基金的正收益金额

4.4.13 报告期内基金的正收益金额

4.4.14 报告期内基金的正收益金额

4.4.15 报告期内基金的正收益金额

4.4.16 报告期内基金的正收益金额

4.4.17 报告期内基金的正收益金额

4.4.18 报告期内基金的正收益金额

4.4.19 报告期内基金的正收益金额

4.4.20 报告期内基金的正收益金额

4.4.21 报告期内基金的正收益金额

4.4.22 报告期内基金的正收益金额

4.4.23 报告期内基金的正收益金额

4.4.24 报告期内基金的正收益金额

4.4.25 报告期内基金的正收益金额

4.4.26 报告期内基金的正收益金额

4.4.27 报告期内基金的正收益金额

4.4.28 报告期内基金的正收益金额

4.4.29 报告期内基金的正收益金额

4.4.30 报告期内基金的正收益金额

4.4.31 报告期内基金的正收益金额

4.4.32 报告期内基金的正收益金额

4.4.33 报告期内基金的正收益金额

4.4.34 报告期内基金的正收益金额

4.4.35 报告期内基金的正收益金额

4.4.36 报告期内基金的正收益金额

4.4.37 报告期内基金的正收益金额

4.4.38 报告期内基金的正收益金额

4.4.39 报告期内基金的正收益金额

4.4.40 报告期内基金的正收益金额

4.4.41 报告期内基金的正收益金额

4.4.42 报告期内基金的正收益金额

4.4.43 报告期内基金的正收益金额

4.4.44 报告期内基金的正收益金额

4.4.45 报告期内基金的正收益金额

4.4.46 报告期内基金的正收益金额

4.4.47 报告期内基金的正收益金额

4.4.48 报告期内基金的正收益金额

4.4.49 报告期内基金的正收益金额

4.4.50 报告期内基金的正收益金额

4.4.51 报告期内基金的正收益金额

4.4.52 报告期内基金的正收益金额

4.4.53 报告期内基金的正收益金额

4.4.54 报告期内基金的正收益金额

4.4.55 报告期内基金的正收益金额

4.4.56 报告期内基金的正收益金额

4.4.57 报告期内基金的正收益金额

4.4.58 报告期内基金的正收益金额

4.4.59 报告期内基金的正收益金额

4.4.60 报告期内基金的正收益金额

4.4.61 报告期内基金的正收益金额

4.4.62 报告期内基金的正收益金额

4.4.63 报告期内基金的正收益金额

4.4.64 报告期内基金的正收益金额

4.4.65 报告期内基金的正收益金额

4.4.66 报告期内基金的正收益金额

4.4.67 报告期内基金的正收益金额

4.4.68 报告期内基金的正收益金额

4.4.69 报告期内基金的正收益金额

4.4.70 报告期内基金的正收益金额

4.4.71 报告期内基金的正收益金额

<p